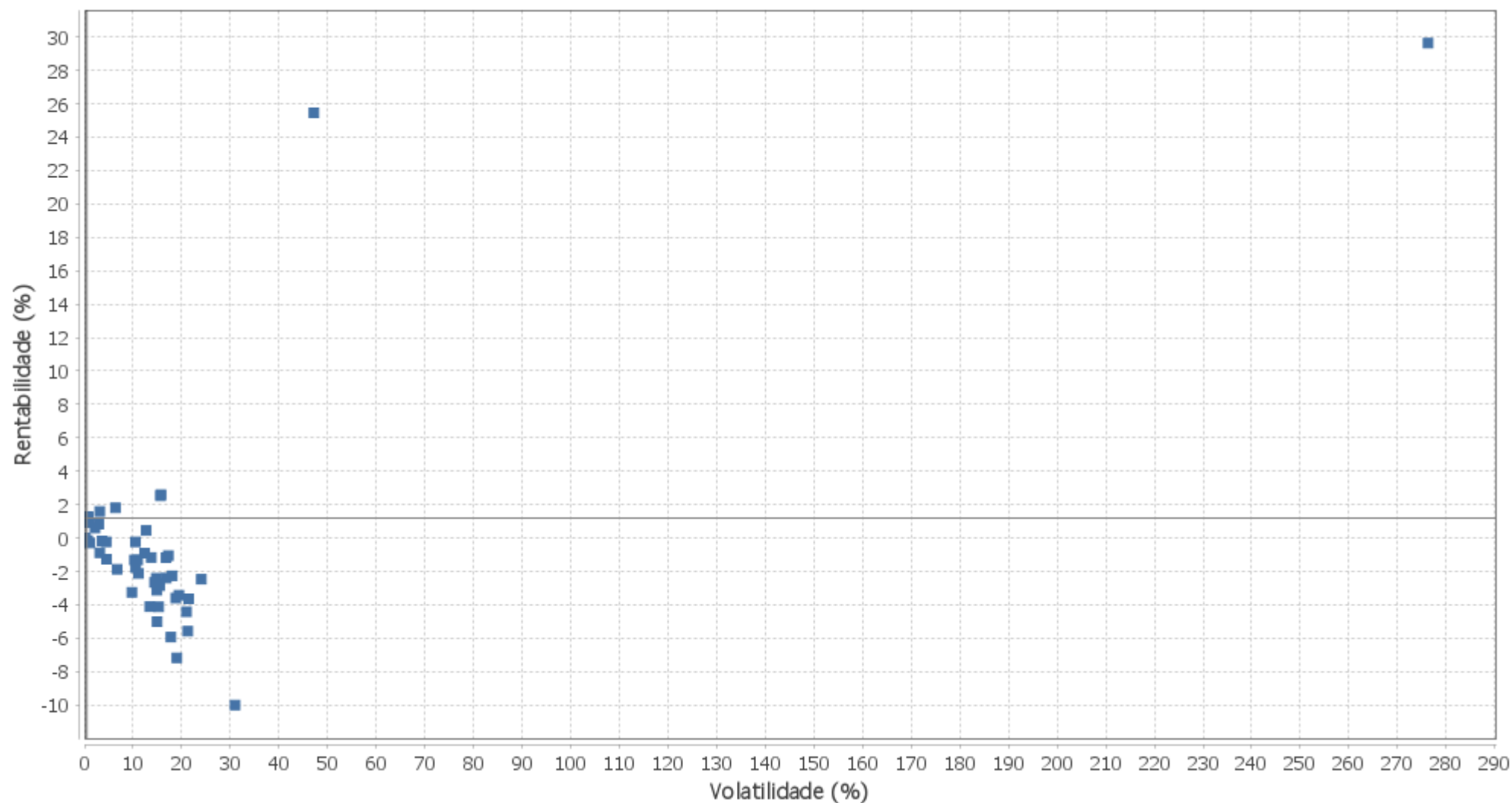


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

FUNDO PREVIDENCIÁRIO - CONSOLIDADO - No Mês



Carteira: FUNDO PREVIDENCIÁRIO - CONSOLIDADO

Data Extrato: 28/02/2025

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0%

Value-At-Risk (R\$): 118.340.709,47

Value-At-Risk: 1,26%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,36	0,16		-0,01	0,28	1,09	7.003.234.168,42	74,40
Artigo 8º	16,48	8,08		1,21	-0,18	-1,94	1.468.737.497,32	15,60
Artigo 9º	10,86	5,61		-0,01	-0,23	-1,54	486.621.276,72	5,17
Artigo 10º	3,67	2,09		0,06	-0,39	-0,43	454.971.912,10	4,83
FUNDO PREVIDENCIÁRIO - CONSOLIDADO	2,54	1,26		1,26	-0,23	0,39	9.413.564.854,56	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,16%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150525 (5,770000%)	0,52	0,23	-0,00	0,23	0,35	1,17	37.285.451,09	0,40
NTN-B 150525 (5,851000%)	0,52	0,23	-0,00	0,23	0,36	1,18	107.655.364,01	1,14
NTN-B 150525 (5,872000%)	0,52	0,23	-0,00	0,23	0,37	1,18	107.764.053,51	1,14
NTN-B 150525 (6,053000%)	0,52	0,23	-0,00	0,23	0,39	1,19	109.492.528,50	1,16
NTN-B 150525 (6,215000%)	0,52	0,23	-0,00	0,23	0,41	1,20	109.721.665,23	1,17
NTN-B 150525 (6,277000%)	0,52	0,23	-0,00	0,23	0,42	1,21	109.682.154,03	1,17
NTN-B 150525 (6,330000%)	0,52	0,23	-0,00	0,23	0,43	1,21	56.337.554,32	0,60
NTN-B 150525 (6,392500%)	0,52	0,23	-0,00	0,23	0,44	1,22	56.777.853,25	0,60
NTN-B 150826 (6,370000%)	0,52	0,23	-0,00	0,23	0,44	1,21	109.418.685,02	1,16
NTN-B 150826 (6,583000%)	0,52	0,23	-0,00	0,23	0,47	1,23	49.650.233,79	0,53
NTN-B 150527 (6,280000%)	0,52	0,23	-0,00	0,23	0,42	1,21	51.769.400,73	0,55
NTN-B 150527 (6,310000%)	0,52	0,23	-0,00	0,23	0,43	1,21	56.680.089,04	0,60
LTN 01072027 (14,310000%)	0,00	0,00	0,00	0,17	0,00	1,07	103.224.044,08	1,10
LTN 01072028 (15,480000%)	0,00	0,00	-0,00	1,30	0,00	1,15	102.838.180,07	1,09
NTN-B 150828 (6,310000%)	0,52	0,23	-0,00	0,23	0,43	1,21	49.790.558,41	0,53
NTN-B 150828 (6,460000%)	0,52	0,23	-0,00	0,23	0,45	1,22	22.035.486,51	0,23
NTN-B 150830 (6,599800%)	0,52	0,23	-0,00	0,23	0,47	1,23	191.035.509,26	2,03
NTN-B 150830 (6,900000%)	0,52	0,23	-0,00	0,23	0,51	1,25	188.836.922,34	2,01

Carteira: FUNDO PREVIDENCIÁRIO - CONSOLIDADO

Data Extrato: 28/02/2025

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150832 (5,760000%)	0,52	0,23	-0,00	0,23	0,35	1,17	36.333.390,16	0,39
NTN-B 150832 (6,310000%)	0,52	0,23	-0,00	0,23	0,43	1,21	49.770.334,19	0,53
NTN-B 150832 (6,323000%)	0,52	0,23	-0,00	0,23	0,43	1,21	53.974.398,31	0,57
NTN-B 150832 (6,435000%)	0,52	0,23	-0,00	0,23	0,45	1,22	33.016.827,24	0,35
NTN-B 150533 (6,250000%)	0,52	0,23	-0,00	0,23	0,42	1,21	55.052.725,93	0,58
NTN-B 150533 (6,290000%)	0,52	0,23	-0,00	0,23	0,43	1,21	55.110.197,94	0,59
NTN-B 150533 (6,346000%)	0,52	0,23	-0,00	0,23	0,43	1,21	55.078.274,41	0,59
NTN-B 150533 (6,389000%)	0,52	0,23	-0,00	0,23	0,44	1,22	55.636.938,22	0,59
NTN-B 150535 (6,000000%)	0,52	0,23	-0,00	0,23	0,38	1,19	102.869.288,46	1,09
NTN-B 150535 (6,030000%)	0,52	0,23	-0,00	0,23	0,39	1,19	56.097.092,58	0,60
NTN-B 150535 (6,110000%)	0,52	0,23	-0,00	0,23	0,40	1,20	78.488.945,31	0,83
NTN-B 150535 (6,120000%)	0,52	0,23	-0,00	0,23	0,40	1,20	51.291.337,10	0,54
NTN-B 150535 (6,123000%)	0,52	0,23	-0,00	0,23	0,40	1,20	27.113.051,43	0,29
NTN-B 150535 (6,133000%)	0,52	0,23	-0,00	0,23	0,40	1,20	21.672.199,85	0,23
NTN-B 150535 (6,270000%)	0,52	0,23	-0,00	0,23	0,42	1,21	112.426.079,41	1,19
NTN-B 150535 (6,290000%)	0,52	0,23	-0,00	0,23	0,43	1,21	51.867.028,48	0,55
NTN-B 150535 (6,380000%)	0,52	0,23	-0,00	0,23	0,44	1,22	55.430.725,92	0,59
NTN-B 150535 (6,428000%)	0,52	0,23	-0,00	0,23	0,45	1,22	32.999.220,58	0,35
NTN-B 150840 (6,034800%)	0,52	0,23	-0,00	0,23	0,39	1,19	54.503.147,82	0,58
NTN-B 150840 (6,053000%)	0,52	0,23	-0,00	0,23	0,39	1,19	51.647.498,10	0,55
NTN-B 150840 (6,091000%)	0,52	0,23	-0,00	0,23	0,40	1,19	51.551.182,76	0,55
NTN-B 150840 (6,165000%)	0,52	0,23	-0,00	0,23	0,41	1,20	27.113.380,42	0,29
NTN-B 150840 (6,190000%)	0,52	0,23	-0,00	0,23	0,41	1,20	104.238.925,43	1,11
NTN-B 150840 (6,210000%)	0,52	0,23	-0,00	0,23	0,41	1,20	21.659.990,42	0,23
NTN-B 150840 (6,213000%)	0,52	0,23	-0,00	0,23	0,41	1,20	27.132.724,08	0,29
NTN-B 150840 (6,350000%)	0,52	0,23	-0,00	0,23	0,43	1,21	55.079.937,35	0,59
NTN-B 150840 (6,380000%)	0,52	0,23	-0,00	0,23	0,44	1,22	55.120.102,98	0,59
NTN-B 150840 (6,392000%)	0,52	0,23	-0,00	0,23	0,44	1,22	53.781.398,76	0,57
NTN-B 150840 (6,400000%)	0,52	0,23	-0,00	0,23	0,44	1,22	53.787.567,27	0,57
NTN-B 150840 (6,451000%)	0,52	0,23	-0,00	0,23	0,45	1,22	55.081.318,98	0,59

Carteira: FUNDO PREVIDENCIÁRIO - CONSOLIDADO

Data Extrato: 28/02/2025

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150840 (6,481000%)	0,52	0,23	-0,00	0,23	0,45	1,22	55.017.958,40	0,58
NTN-B 150840 (6,499000%)	0,52	0,23	-0,00	0,23	0,46	1,22	107.756.039,79	1,14
NTN-B 150840 (6,600000%)	0,52	0,23	-0,00	0,23	0,47	1,23	186.751.338,73	1,98
NTN-B 150840 (7,182000%)	0,52	0,23	-0,00	0,23	0,55	1,28	99.333.433,75	1,06
NTN-B 150545 (6,020000%)	0,52	0,23	-0,00	0,23	0,39	1,19	51.654.954,93	0,55
NTN-B 150545 (6,090000%)	0,52	0,23	-0,00	0,23	0,40	1,19	262.317.807,80	2,79
NTN-B 150545 (6,093000%)	0,52	0,23	-0,00	0,23	0,40	1,19	51.588.132,77	0,55
NTN-B 150545 (6,100500%)	0,52	0,23	-0,00	0,23	0,40	1,19	36.567.265,75	0,39
NTN-B 150545 (6,107600%)	0,52	0,23	-0,00	0,23	0,40	1,19	96.846.865,30	1,03
NTN-B 150545 (6,140000%)	0,52	0,23	-0,00	0,23	0,40	1,20	105.143.370,07	1,12
NTN-B 150545 (6,150000%)	0,52	0,23	-0,00	0,23	0,41	1,20	103.980.521,49	1,10
NTN-B 150545 (6,190000%)	0,52	0,23	-0,00	0,23	0,41	1,20	51.340.161,23	0,55
NTN-B 150545 (6,210000%)	0,52	0,23	-0,00	0,23	0,41	1,20	51.917.603,92	0,55
NTN-B 150545 (6,220000%)	0,52	0,23	-0,00	0,23	0,42	1,20	36.327.125,37	0,39
NTN-B 150545 (6,241500%)	0,52	0,23	-0,00	0,23	0,42	1,21	52.479.013,10	0,56
NTN-B 150545 (6,270000%)	0,52	0,23	-0,00	0,23	0,42	1,21	51.765.577,77	0,55
NTN-B 150545 (6,340000%)	0,52	0,23	-0,00	0,23	0,43	1,21	28.558.005,92	0,30
NTN-B 150545 (6,360000%)	0,52	0,23	-0,00	0,23	0,44	1,21	104.445.015,39	1,11
NTN-B 150545 (6,410000%)	0,52	0,23	-0,00	0,23	0,44	1,22	104.258.197,02	1,11
NTN-B 150545 (6,420000%)	0,52	0,23	-0,00	0,23	0,44	1,22	104.261.536,32	1,11
Sub-total	0,50	0,22	-0,01		0,44	1,20	4.957.230.887,90	52,66

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI	2,17	1,18	0,00	0,12	-0,18	0,60	10.513.908,65	0,11
BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,04	0,04	0,00	0,03	-1,71	0,92	6.440.147,88	0,07
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,02	0,03	0,00	0,02	-0,42	0,98	781.248,88	0,01
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI	0,08	0,06	0,00	0,05	-0,33	0,96	4.879.218,55	0,05
TREND PÓS-FIXADO FIC FI RENDA FIXA SIMPLES	0,05	0,06	0,00	0,06	-0,16	0,98	92.162.693,13	0,98

Carteira: FUNDO PREVIDENCIÁRIO - CONSOLIDADO

Data Extrato: 28/02/2025

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Sub-total	0,20	0,12	0,00		-0,23	0,94	114.777.217,09	1,22

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,04	0,06	0,00	0,05	0,33	1,00	456.202.721,21	4,85
BRABESCO FIF RENDA FIXA REFERENCIADA DI PREMIUM - RESPONSABILIDADE LIMITADA	0,03	0,04	-0,00	0,03	0,56	1,00	386.748.607,26	4,11
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,03	0,04	0,00	0,03	0,64	1,01	153.937.951,22	1,64
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,03	0,04	0,00	0,02	0,71	1,00	10.064.039,98	0,11
SAFRA DI MASTER FI RF REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	0,04	0,04	-0,00	0,03	0,30	1,00	204.356.360,09	2,17
Sub-total	0,03	0,04	0,00		0,59	1,00	1.211.309.679,76	12,87

Artigo 7º IV

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
LETRA FINANCEIRA - BC6 - C6 BANK SA 6,85% a.a	0,00	0,19	-0,00	0,26	0,00	0,00	260.430.364,52	2,77
LETRA FINANCEIRA - BCO MASTER 7,8% a.a	2,94	0,24	-0,00	0,29	-0,05	0,83	54.067.243,05	0,57
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,30% aa	0,00	0,17	0,00	0,24	0,00	0,00	42.298.836,99	0,45
LETRA FINANCEIRA - DAYC - BCO DAYCOVAL SA 6,10% a.a	0,00	0,20	-0,00	0,27	0,00	0,00	52.245.550,49	0,56
Sub-total	0,00	0,18	-0,00		0,00	0,00	409.041.995,05	4,35

Artigo 7º V, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BNP PARIBAS MATCH DI FI RF REFERENCIADO CRÉDITO PRIVADO	0,02	0,03	-0,00	0,01	0,47	0,99	15.220.369,60	0,16
BTG PACTUAL CREDITO CORPORATIVO I FIQ DE FI DE RF CREDITO PRIVADO	0,10	0,08	0,00	0,08	1,30	1,12	66.267.626,61	0,70
INTER CORPORATE FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,02	0,03	0,00	0,02	0,20	0,99	41.551.127,86	0,44
ITAU HIGH GRADE RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO FIF CIC RESPONSABILIDADE LIMITADA	0,04	0,02	0,00	0,02	0,78	1,02	9.138.063,81	0,10
PORTO SEGURO FI RF REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO	0,04	0,04	0,00	0,04	1,11	1,03	116.610.116,41	1,24

Carteira: FUNDO PREVIDENCIÁRIO - CONSOLIDADO

Data Extrato: 28/02/2025

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SAFRA EXTRA BANCOS FIC DE FI RF CREDITO PRIVADO	0,07	0,03	0,00	0,02	-0,05	0,98	62.087.084,33	0,66
Sub-total	0,03	0,04	0,00		1,60	1,03	310.874.388,62	3,30

Renda Variável

Value-At-Risk: 8,08%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	18,78	8,05	0,01	2,25	-0,24	-3,60	13.142.599,34	0,14
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC FIA	9,75	3,28	0,01	9,70	-0,43	-3,25	48.112.925,00	0,51
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	15,26	6,24	0,03	2,78	-0,33	-4,12	50.084.632,08	0,53
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	14,93	6,43	0,05	2,43	-0,40	-5,01	87.085.479,82	0,93
BRADESCO FIA MID SMALL CAPS	18,04	9,87	0,05	3,27	-0,18	-2,27	55.394.099,46	0,59
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	24,03	11,72	0,04	5,43	-0,14	-2,47	34.367.824,07	0,37
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	16,82	8,13	0,14	3,91	-0,20	-2,41	173.067.006,14	1,84
CONSTANCIA FUNDAMENTO FI DE ACOES	15,24	5,65	0,00	3,96	-0,24	-2,75	1.078.428,02	0,01
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FIA	15,46	7,98	0,01	0,95	-0,25	-2,85	16.224.357,85	0,17
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	21,43	10,58	0,04	4,92	-0,22	-3,64	37.462.070,65	0,40
GUEPARDO AÇÕES INSTITUCIONAL FI DE AÇÕES	21,24	10,08	0,22	3,98	-0,31	-5,58	228.250.079,75	2,42
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	14,41	7,05	0,05	2,18	-0,25	-2,66	76.996.758,17	0,82
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC FIA	20,98	10,49	0,06	1,78	-0,26	-4,42	56.653.431,99	0,60
OCCAM FIC FIA	10,53	4,65	0,05	3,94	-0,26	-1,77	103.875.615,05	1,10
PRINCIPAL CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA	19,42	10,20	0,01	3,51	-0,23	-3,43	14.252.371,19	0,15
TARPON ATLANTICUS INSTITUCIONAL FIC FIA RESPONSABILIDADE LIMITADA	47,17	22,89	0,11	19,27	0,52	25,45	66.443.162,86	0,71
TARPON GT INSTITUCIONAL FIC FI EM AÇÕES	15,64	8,59	0,04	5,07	0,10	2,53	54.134.161,84	0,58
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC FIA	15,72	8,69	0,09	5,42	0,10	2,59	112.425.555,22	1,19
TRIGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC DE FIA	17,77	9,19	0,03	5,81	-0,39	-5,93	36.063.163,14	0,38
TRIGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC FIA	18,99	10,53	0,05	6,48	-0,43	-7,18	58.113.871,63	0,62
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FIA	17,25	8,18	0,08	2,44	-0,12	-1,05	102.619.501,83	1,09
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	14,77	6,83	0,03	2,31	-0,23	-2,41	42.890.402,22	0,46
Sub-total	16,48	8,08	1,21		-0,18	-1,94	1.468.737.497,32	15,60

Carteira: FUNDO PREVIDENCIÁRIO - CONSOLIDADO

Data Extrato: 28/02/2025

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 5,61%

Artigo 9º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB MULT GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	13,73	8,69	-0,01	8,75	-0,16	-1,17	77.197.651,35	0,82
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA IE	10,48	7,52	-0,00	7,66	-0,12	-0,23	46.647.562,10	0,50
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	30,96	15,34	0,01	13,64	-0,36	-10,01	28.698.629,17	0,30
JBONDS FIF CIC MULT RESP LTDA	3,15	1,42	0,00	6,57	0,19	1,59	102.820.550,00	1,09
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS USD FIF CIC DE AÇÕES IS IE - RESPONSABILIDADE LIMITADA	13,44	7,96	-0,00	8,40	-0,38	-4,11	37.102.617,70	0,39
Sub-total	8,62	5,57	-0,01		-0,28	-1,41	292.467.010,32	3,11

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FIA	14,89	8,13	0,01	7,01	-0,28	-3,13	97.004.228,67	1,03
ITAÚ BDR NÍVEL 1 AÇÕES FIF CIC RESP LIMITADA	12,69	7,18	-0,00	6,16	-0,04	0,45	52.015.646,36	0,55
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	16,78	8,20	-0,00	3,49	-0,13	-1,18	45.134.391,37	0,48
Sub-total	14,23	7,36	0,00		-0,19	-1,74	194.154.266,40	2,06

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 2,09%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	11,11	7,07	0,01	2,15	-0,28	-2,13	26.048.274,02	0,28
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO CÍCLICO II FIC FIF MULTIMERCADO LP - RESP LIMIT	3,62	3,09	0,00	8,38	-0,32	-0,17	21.514.075,38	0,23
ICATU VANGUARDA IGARATÉ LONG BIASED FI MULTIMERCADO	10,29	4,46	0,01	4,63	-0,22	-1,32	20.434.726,34	0,22
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	10,95	7,52	0,01	6,49	-0,21	-1,32	16.452.317,41	0,17
RIO BRAVO PROTEÇÃO PORTFÓLIO FI FINANCEIRO MULTIMERCADO - RESPONSABILIDADE LIMITADA	4,48	3,07	0,00	3,07	-0,27	-0,24	37.397.020,50	0,40
SAFRA S&P REAIS PB FIC FIM	12,37	7,06	0,03	1,71	-0,15	-0,91	87.791.485,13	0,93

Carteira: FUNDO PREVIDENCIÁRIO - CONSOLIDADO

Data Extrato: 28/02/2025

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Sub-total	7,96	4,54	0,06		-0,24	-0,94	209.637.898,78	2,23
Artigo 10º II								
Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BTG ECONOMIA REAL FIP MULTISTRATEGIA	0,59	0,04	0,00	0,17	-1,96	-0,17	41.568.940,00	0,44
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL II FIP - MULTISTRATÉGIA	3,15	0,20	0,00	0,27	-0,59	-0,88	16.035.362,95	0,17
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA III FEEDER FIP MULTISTRATÉGIA	276,26	44,61	0,00	44,60	0,10	29,63	1.546.751,29	0,02
BTG PACTUAL INVESTIMENTOS DE IMPACTO FIP – MULTISTRATÉGIA	0,55	0,05	0,00	0,17	-2,06	-0,16	32.847.045,64	0,35
KINEA PRIVATE EQUITY V FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTISTRATÉGIA	6,72	0,08	0,00	0,20	-0,43	-1,88	63.973.020,19	0,68
PÁTRIA INFRAESTRUTURA V ADVISORY FIP MULTISTRATÉGIA	4,54	3,47	-0,00	3,47	-0,50	-1,27	6.065.339,22	0,06
PÁTRIA PRIVATE EQUITY VII ADVISORY FIP MULTISTRATÉGIA CLASSE C	1,08	0,24	0,00	0,30	-1,19	-0,31	77.079.516,47	0,82
VINCI STRATEGIC PARTNERS I FIP MULTISTRATEGIA	6,38	0,22	0,00	0,22	0,13	1,81	6.218.037,56	0,07
Sub-total	0,00	0,31	0,00		0,00	0,00	245.334.013,32	2,61

(1) Volatilidade anualizada do ativo no período (%)

(2) VaR (Value-at-Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)

(3) Component VaR: contribuição no risco da carteira (%)

(4) BVaR (Benchmark-Value at Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)

(5) Limite Política de Investimentos (%)